

GMM NAVIGATOR WORLD BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2017

Τρίμηνο: Α

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN GBP	0,0100	1,16886608	0,01
CASH ACCOUNT IN NOK	659,5000	0,10907147	71,93
CASH ACCOUNT IN CAD	6.071,5600	0,70101647	4.256,26
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			283.898,27
CASH ACCOUNT IN AUD	10.136,2000	0,71520526	7.249,46
CASH ACCOUNT IN USD	10.061,3300	0,93536620	9.411,03
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			797,08
CASH ACCOUNT IN RUB	350.039,3000	0,01658017	5.803,71
ΣΥΝΟΛΟ I.1			311.487,75
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 4.75 25/6/2019	1.000,0000	109,00050000	109.000,50
- Isin: XS1081101807			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 25-JUN-14 - 25-JUN-19 Επιδόκιο: 4.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 3.25 18/1/2023	2.000,0000	104,66650000	209.333,00
- Isin: CY0146250812			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-16 - 18-JAN-23 Επιδόκιο: 3.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BB-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 9.25 19/1/2027	1.000,0000	106,75000000	106.750,00
- Isin: XS1551761569			
- Εκδότης: BANK OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-JAN-17 - 19-JAN-27 Επιδόκιο: 9.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Caa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			425.083,50
ΣΥΝΟΛΟ I.2			425.083,50
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			736.571,25
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
EXPORT CANADA 08/8/2017	2.950,0000	71,84451438	211.941,32
- Isin: AU3CB0197572			
- Εκδότης: EXPORT DEVELOPMNT CANADA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-AUG-12 - 08-AUG-17 Επιδόκιο: 3.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EUROPEAN INV 10 19/6/2018	3.100,0000	30,11656805	93.361,36
- Isin: XS1136802615			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 19-NOV-14 - 19-JUN-18 Επιδόκιο: 10%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTL FINANCE 17/12/2018	100.000,0000	1,68353423	168.353,42

- Isin: XS1333828280			
- Εκδότης: INTL FINANCE CORP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 17-DEC-15 - 17-DEC-18	Επιτόκιο: 8.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PIRELLI INT 18/11/2019	1.000,0000	101,49000000	101.490,00
- Isin: XS1139287350			
- Εκδότης: PIRELLI INTERNATIONAL			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-NOV-14 - 18-NOV-19	Επιτόκιο: 1.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
Q & R UK LTD 21/7/2017 6	1.500,0000	100,00000000	150.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-20	Επιτόκιο: 6%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ASTALDI SPA, 1/12/2020	1.000,0000	105,00000000	105.000,00
- Isin: XS1000393899			
- Εκδότης: ASTALDI SPA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-DEC-13 - 01-DEC-20	Επιτόκιο: 7.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
FNCIM 4.5% 19/1/2021	1.000,0000	112,37500000	112.375,00
- Isin: XS0999654873			
- Εκδότης: LEONARDO-FINMECCANICA SP			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 05-DEC-13 - 19-JAN-21	Επιτόκιο: 4.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
GERDAU TRADE 30/1/2021	1.000,0000	98,21345057	98.213,45
- Isin: USG3925DAA84			
- Εκδότης: GERDAU TRADE INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 01-OCT-10 - 30-JAN-21	Επιτόκιο: 5.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF ARGENTINA 22/4/2021	1.500,0000	100,45832944	150.687,49
- Isin: USP04808AA23			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-APR-16 - 22-APR-21	Επιτόκιο: 6.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	1.000,0000	102,71000000	102.710,00
- Isin: XS1405774727			
- Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-SEP-16 - 15-SEP-21	Επιτόκιο: 6.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
HELLENIC PETRO. 4.875% 14/10/21	1.000,0000	100,51900000	100.519,00
- Isin: XS1500377517			
- Εκδότης: HELLENIC PETROLEUM FINAN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-OCT-16 - 14-OCT-21	Επιτόκιο: 4.875%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OPAP 21/3/2022	900,0000	100,66000000	90.594,00

- Isin: GRC4191173B0			
- Εκδότης: OPAP SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-MAR-17 - 21-MAR-22	Επιτόκιο: 3.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
BRF 3/6/2022	1.000,0000	99,57600000	99.576,00
- Isin: XS1242327168			
- Εκδότης: BRF SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 03-JUN-15 - 03-JUN-22	Επιτόκιο: 2.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
NOVATEK 13/12/2022	2.000,0000	95,17351043	190.347,02
- Isin: XS0864383723			
- Εκδότης: NOVATEK FIN LTD			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-12 - 13-DEC-22	Επιτόκιο: 4.422%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
SIGMA ALIMENTOS 7/2/2024	1.000,0000	102,65000000	102.650,00
- Isin: XS1562623584			
- Εκδότης: SIGMA ALIMENTOS SA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 07-FEB-17 - 07-FEB-24	Επιτόκιο: 2.625%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: BBB			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROBRAS 4.75% 14/01/2025	1.000,0000	102,87500000	102.875,00
- Isin: XS0982711714			
- Εκδότης: PETROBRAS GLOBAL FINANCE			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JAN-14 - 14-JAN-25	Επιτόκιο: 4.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B2			
- Πρόσθετοι Όροι:			
OBRIGACOES DO TESOIRO 14/04/2027	1.000,0000	101,26700000	101.267,00
- Isin: PTOTEUOE0019			
- Εκδότης: OBRIGACOES DO TESOIRO			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 18-JAN-17 - 14-APR-27	Επιτόκιο: 4.125%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Ba1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REPUBLIC OF INDONESIA 14/6/2028	1.000,0000	107,01400000	107.014,00
- Isin: XS1432493440			
- Εκδότης: REPUBLIC OF INDONESIA			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 14-JUN-16 - 14-JUN-28	Επιτόκιο: 3.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			2.188.974,06
FLOATING			
GOLDMAN SACHS 15/11/2021	1.000,0000	94,56832850	94.568,33
- Isin: US38145GAF72			
- Εκδότης: GOLDMAN SACHS GROUP INC			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 27-SEP-16 - 15-NOV-21	Επιτόκιο: 2.209%		
- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: A3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PETROLEOS MEXICANOS 11/3/2022	1.000,0000	100,37788794	100.377,89
- Isin: US71656MBN83			
- Εκδότης: PETROLEOS MEXICANOS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 13-DEC-16 - 11-MAR-22	Επιτόκιο: 4.7696%		

- Τύπος Επιτοκίου: Floating	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Baa3			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FLOATING			194.946,22
STEPPED			
REPUBLIC OF ARGENTINA 15/01/2027	1.000,0000	93,50000000	93.500,00
- Isin: XS1503160498			
- Εκδότης: REPUBLIC OF ARGENTINA			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 12-OCT-16 - 15-JAN-27	Επιτόκιο: 5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Stepped	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B3			
- Πρόσθετοι Όροι: SINKABLE			
ΣΥΝΟΛΟ STEPPED			93.500,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			2.477.420,28
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 6% 20/6/2018	3.127,2284	49,42000000	154.547,63
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18	Επιτόκιο: 6%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CELTONA LTD 15/12/2019	578,0000	100,00000000	57.800,00
- Isin:			
- Εκδότης: CELTONA LTD			
- Ην/νία Έναρξης - Λήξης: 15-DEC-16 - 15-DEC-19	Επιτόκιο: 3%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή:		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση:			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			212.347,63
ΣΥΝΟΛΟ II.2			212.347,63
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
LUKOIL PJSC-SPON ADR	1.000,0000	49,53699373	49.536,99
QUALITY & RELIABILITY SA	167.249,0000	0,19900000	33.282,55
LANXESS AG	750,0000	62,89000000	47.167,50
ΜΥΤΙΛΙΝΕΟΣ HOLDINGS S.A.	8.700,0000	7,10000000	61.770,00
ABB LTD-REG	2.350,0000	21,90538519	51.477,66
NATIXIS	9.000,0000	5,77600000	51.984,00
MMC NORILSK NICKEL JSC ADR	3.750,0000	14,70395660	55.139,84
UBS GROUP	3.400,0000	14,98691099	50.955,50
ΣΥΝΟΛΟ II.3			401.314,04
4. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			30.996,15
MARGIN IN USD/BETA	37.067,4100	0,93536620	34.671,60
ΣΥΝΟΛΟ II.4			65.667,75
5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ			
PROSHARES SHORT 7-10YR	5.820,0000	26,73276588	155.584,70
LYX ETF TH-REUTERS CORECOMMO	8.750,0000	15,94500000	139.518,75
ΣΥΝΟΛΟ II.5			295.103,45
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			3.451.853,15
ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)			4.188.424,40
ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			34.913,65
ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ			4.223.338,05

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FUTURES ON CURRENCY

EUR FX USD FUT JUN17

7,0000

1,07220000

877.537,18

- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES

ΣΥΝΟΛΟ IV.1

877.537,18

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)

877.537,18

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

877.537,18

GMM GLOBAL MONEY MANAGERS LTD
Στασίνου 36, 2003 Λευκωσία, Κύπρος